

茨城ファンド (愛称：コラボいばらき)

運用報告書 (全体版) 第18期

(決算日 2020年7月29日)

(作成対象期間 2019年7月30日~2020年7月29日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、茨城企業の株式に投資し、中長期的な信託財産の成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先 (コールセンター)
TEL 0120-106212
(営業日の9:00~17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式	
信託期間	無期限	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	茨城マザーファンドの受益証券
	茨城マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			T O P I X		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
14期末(2016年7月29日)	円 10,688	円 0	% △14.1	1,322.74	% △19.0	% 92.7	% 5.8	百万円 3,486
15期末(2017年7月31日)	12,519	600	22.7	1,618.61	22.4	93.7	5.8	4,042
16期末(2018年7月30日)	13,285	200	7.7	1,768.15	9.2	95.7	4.4	4,311
17期末(2019年7月29日)	11,496	0	△13.5	1,568.57	△11.3	92.9	6.7	3,741
18期末(2020年7月29日)	11,652	50	1.8	1,549.04	△ 1.2	92.0	7.4	3,762

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

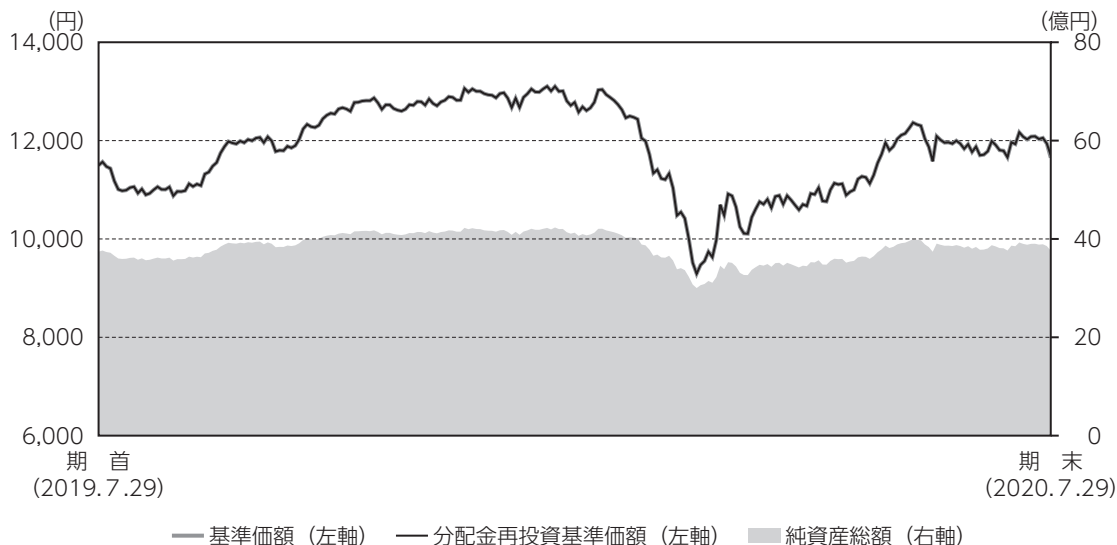
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額・騰落率

期首：11,496円

期末：11,652円（分配金50円）

騰落率：1.8%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

茨城企業（※）の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行った結果、国内株式市況はほぼ横ばいだったものの、個別銘柄などがプラスに寄与したことで、基準価額は上昇しました。

※ 株式公開企業に限る。茨城県内に本社を置いている企業と、茨城県に進出し雇用を創出している企業。

茨城ファンド

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率		(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2019年 7月29日	円	%		%	%	%
	11,496	—	1,568.57	—	92.9	6.7
7 月末	11,472	△ 0.2	1,565.14	△ 0.2	92.8	6.7
8 月末	11,122	△ 3.3	1,511.86	△ 3.6	92.4	7.0
9 月末	11,959	4.0	1,587.80	1.2	92.8	6.5
10 月末	12,643	10.0	1,667.01	6.3	93.2	6.2
11 月末	12,722	10.7	1,699.36	8.3	94.0	5.5
12 月末	12,862	11.9	1,721.36	9.7	94.5	4.9
2020年 1 月末	12,687	10.4	1,684.44	7.4	94.4	5.2
2 月末	11,336	△ 1.4	1,510.87	△ 3.7	94.6	4.8
3 月末	10,650	△ 7.4	1,403.04	△10.6	93.7	5.9
4 月末	11,041	△ 4.0	1,464.03	△ 6.7	91.4	8.1
5 月末	11,803	2.7	1,563.67	△ 0.3	91.4	8.1
6 月末	11,877	3.3	1,558.77	△ 0.6	91.4	8.1
(期末) 2020年 7月29日	11,702	1.8	1,549.04	△ 1.2	92.0	7.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2019.7.30~2020.7.29)

国内株式市況

国内株式市況は、大きく下落した局面もありましたが、ほぼ横ばいでした。

国内株式市況は、当作成期首より、米国が対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、2019年9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落したことに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策を受けて株価は上昇に転じました。新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したことや、国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感されました。しかし6月中旬以降は、米国において新型コロナウイルスの感染拡大が再び懸念され、株価は頭打ちとなりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「茨城マザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

茨城マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、茨城企業の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめざした運用を継続してまいります。

ポートフォリオについて

(2019.7.30~2020.7.29)

■当ファンド

「茨城マザーファンド」の受益証券組入比率は、当作成期を通じておおむね100%程度を維持しました。

■茨城マザーファンド

運用の基本方針に基づき、茨城企業に投資を行いました。

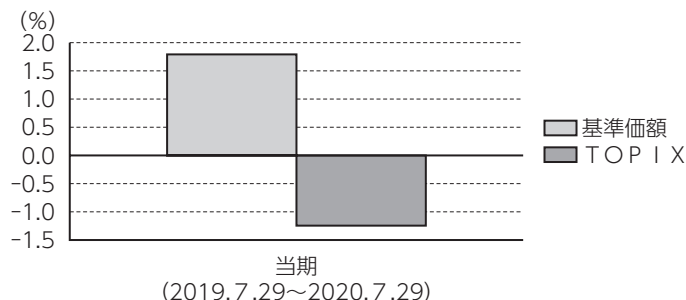
茨城県内に本社を置いている企業の株式に対しては、時価総額に応じた投資比率で、茨城県に進出し雇用を創出している企業の株式に対しては、時価総額と県内従業員数など茨城県との関連度を考慮して銘柄選定を行い、それぞれの時価総額に応じた比率に一定の値を乗じた投資比率で組み入れを行いました。

株式の業種別構成は、食料品や化学の組入比率がTOPIXに比べて高くなっております。また、当作成期を通じて通常の状態での株式の実質組入比率（株式先物を含む。）を98~100%程度としました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2019年7月30日 ～2020年7月29日	
当期分配金（税込み） (円)	50	
対基準価額比率 (%)	0.43	
当期の収益 (円)	50	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	3,534	

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当	期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	164.15円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		0.00
(c) 収益調整金		777.68
(d) 分配準備積立金		2,642.90
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		3,584.73
(f) 分配金		50.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		3,534.73

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

「茨城マザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■茨城マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、茨城企業の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめざした運用を継続してまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019.7.30~2020.7.29)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	127円	1.075%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,835円です。
(投 信 会 社)	(65)	(0.548)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(52)	(0.439)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(10)	(0.088)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.006	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	128	1.082	

(注1) 当作成期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

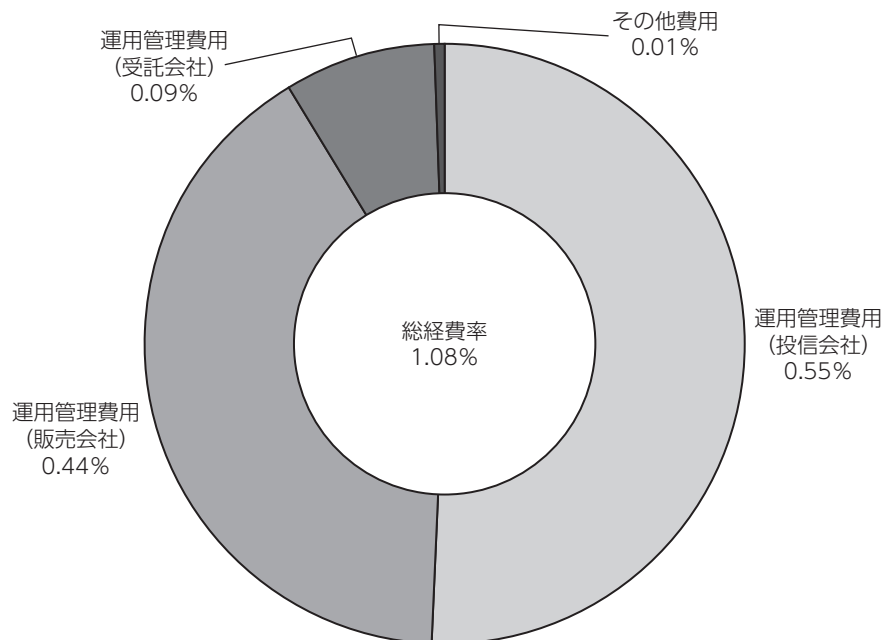
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.08%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2019年7月30日から2020年7月29日まで)

	設 定		解 約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
茨城マザーファンド	21,606	52,210	51,001	127,880

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2019年7月30日から2020年7月29日まで)

項 目	当 期
	茨 城 マ ザ ー フ ァ ン ド
(a) 期中の株式売買金額	98,781千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,982,974千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.02

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2019年7月30日から2020年7月29日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	A	B/A	C	D/C	うち利害関係人との取引状況	
	百万円	うち利害関係人との取引状況B	百万円	百万円	うち利害関係人との取引状況D	D/C
株式	0	0	97	97	—	—
株式先物取引	1,226	—	—	1,224	—	—
コール・ローン	63,361	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合89.7%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2019年7月30日から2020年7月29日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	77千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B)÷(A)	1.0%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期	末
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
茨城マザーファンド	1,590,693	1,561,297	3,770,846

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年7月29日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
茨城マザーファンド	3,770,846	99.3
コール・ローン等、その他	27,627	0.7
投資信託財産総額	3,798,474	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年7月29日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,798,474,010円
コール・ローン等	27,627,173
茨城マザーファンド(評価額)	3,770,846,837
(B) 負債	36,059,545
未払収益分配金	16,144,379
未払信託報酬	19,814,158
その他未払費用	101,008
(C) 純資産総額(A - B)	3,762,414,465
元本	3,228,875,918
次期繰越損益金	533,538,547
(D) 受益権総口数	3,228,875,918口
1万口当り基準価額(C/D)	11,652円

*期首における元本額は3,254,178,998円、当作成期間中における追加設定元本額は60,969,658円、同解約元本額は86,272,738円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は11,652円です。

■損益の状況

当期 自2019年7月30日 至2020年7月29日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 8,754円
受取利息	435
支払利息	△ 9,189
(B) 有価証券売買損益	105,870,804
売買益	114,709,245
売買損	△ 8,838,441
(C) 信託報酬等	△ 41,435,549
(D) 当期損益金(A + B + C)	64,426,501
(E) 前期繰越損益金	236,399,963
(F) 追加信託差損益金	248,856,462
(配当等相当額)	(251,103,229)
(売買損益相当額)	(△ 2,246,767)
(G) 合計(D + E + F)	549,682,926
(H) 収益分配金	△ 16,144,379
次期繰越損益金(G + H)	533,538,547
追加信託差損益金	248,856,462
(配当等相当額)	(251,103,229)
(売買損益相当額)	(△ 2,246,767)
分配準備積立金	890,219,353
繰越損益金	△605,537,268

- (注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	53,002,542円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	251,103,229
(d) 分配準備積立金	853,361,190
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,157,466,961
(f) 分配金	16,144,379
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,141,322,582
(h) 受益権総口数	3,228,875,918口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金

50円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

茨城マザーファンド

運用報告書 第18期 (決算日 2020年7月29日)

(作成対象期間 2019年7月30日～2020年7月29日)

茨城マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

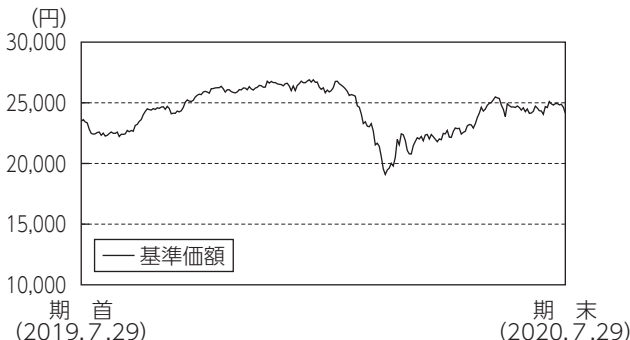
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 率	株 先 物 率
	円	%	(参考指数)	%		
(期首)2019年7月29日	23,471	-	1,568.57	-	93.1	6.7
7月末	23,424	△ 0.2	1,565.14	△ 0.2	93.0	6.7
8月末	22,726	△ 3.2	1,511.86	△ 3.6	92.6	7.0
9月末	24,463	△ 4.2	1,587.80	1.2	93.0	6.6
10月末	25,888	10.3	1,667.01	6.3	93.4	6.2
11月末	26,074	11.1	1,699.36	8.3	94.2	5.5
12月末	26,384	12.4	1,721.36	9.7	94.7	4.9
2020年1月末	26,049	11.0	1,684.44	7.4	94.6	5.2
2月末	23,290	△ 0.8	1,510.87	△ 3.7	94.8	4.8
3月末	21,899	△ 6.7	1,403.04	△ 10.6	93.9	5.9
4月末	22,723	△ 3.2	1,464.03	△ 6.7	91.6	8.1
5月末	24,317	△ 3.6	1,563.67	△ 0.3	91.6	8.1
6月末	24,492	4.4	1,558.77	△ 0.6	91.6	8.1
(期末)2020年7月29日	24,152	2.9	1,549.04	△ 1.2	91.8	7.4

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。
 上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
 (注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：23,471円 期末：24,152円 騰落率：2.9%

【基準価額の主な変動要因】

茨城企業（※）の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめぐって運用を行った結果、国内株式市況はほぼ横ばいだったものの、個別銘柄などがプラスに寄与したことで、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご覧ください。

※株式公開企業に限る。茨城県内に本社を置いている企業と、茨城県に進出し雇用を創出している企業。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、大きく下落した局面もありましたが、ほぼ横ばいでした。

国内株式市況は、当作成期首より、米国が対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、2019年9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1

月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落したことに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策を受けて株価は上昇に転じました。新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したことや、国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感されました。しかし6月中旬以降は、米国において新型コロナウイルスの感染拡大が再び懸念され、株価は頭打ちとなりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用の基本方針に基づき、茨城企業の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめぐって運用を継続してまいります。

◆ポートフォリオについて

運用の基本方針に基づき、茨城企業に投資を行いました。茨城県内に本社を置いている企業の株式に対しては、時価総額に応じた投資比率で、茨城県に進出し雇用を創出している企業の株式に対しては、時価総額と県内従業員数など茨城県との関連度を考慮して銘柄選定を行い、それぞれの時価総額に応じた比率に一定の値を乗じた投資比率で組み入れを行いました。

株式の業種別構成は、食料品や化学の組入比率がT O P I X に比べて高くなっております。また、当作成期を通じて通常の状態での株式の実質組入比率（株式先物を含む。）を98~100%程度としました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用の基本方針に基づき、茨城企業の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめぐって運用を継続してまいります。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)
(先物・オプション)	(0)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	1

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2019年7月30日から2020年7月29日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 1.6 (-)	千円 944 (-)	千株 16.4	千円 97,837

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
 (注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2019年7月30日から2020年7月29日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 株式先物取引	百万円 1,226	百万円 1,224	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2019年7月30日から2020年7月29日まで)

買 付					売 付				
銘	柄	株 数	金 額	平均単価	銘	柄	株 数	金 額	平均単価
ホリイフードサービス		千株 1.6	千円 944	円 590	日立ハイテク 日立化成		千株 6.5 9.9	千円 52,000 45,837	円 8,000 4,630

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘 柄	期 首 当 期 末			銘 柄	期 首 当 期 末			銘 柄	期 首 当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
建設業 (4.9%)	千株	千株	千円	信越化学	千株	千株	千円	丸一鋼管	千株	千株	千円
NIPPPO	5.7	5.7	16,113	エア・ウォーター	20.3	20.3	263,392	日立金属	4.5	4.5	11,929
住友林業	8.7	8.7	11,205	カネカ	9.4	9.4	13,573	シンニッタン	20.4	20.4	26,989
大和ハウス	31.7	31.7	77,141	三菱瓦斯化学	3.2	3.2	8,531	三菱マテリアル	26.1	26.1	5,663
積水ハウス	32.8	32.8	67,568	J S R	11	11	18,854	非鉄金属 (0.4%)			
日揮ホールディングス	12.3	12.3	13,370	三菱ケミカルHDGS	10.7	10.7	24,545	三菱マテリアル	6.2	6.2	13,956
晩飯島工業	1	1	1,496	積水化学	71.6	71.6	43,446	金属製品 (0.3%)			
食料品 (14.4%)				アイカ工業	23	23	34,086	東洋製罐グループHD	9.6	9.6	11,356
山崎製パン	10.5	10.5	18,952	日立化成	3.2	3.2	11,424	機械 (17.6%)			
カルビー	6.4	6.4	19,680	日本化薬	9.9	-	-	SMC	3.2	3.2	183,008
ヤクルト	8.1	8.1	51,597	日油	8.4	8.4	9,114	小松製作所	46.2	46.2	105,105
明治ホールディングス	7.3	7.3	61,831	花王	4.1	4.1	16,564	日立建機	10.2	10.2	30,957
日本ハム	4.9	4.9	21,315	D I C	23.2	23.2	192,281	クボタ	58.5	58.5	92,371
アサヒグループホールディングス	23	23	80,983	エフピコ	4.5	4.5	12,114	ダイキン工業	13.9	13.9	260,903
キリンHD	43.4	43.4	90,423	医薬品 (9.1%)	2.1	2.1	17,934	電気機器 (14.7%)			
不二製油グループ	4.2	4.2	12,108	アステラス製薬	89.7	89.7	155,181	日立	46	46	146,050
キユーピー	7.1	7.1	13,632	日本新薬	3.3	3.3	28,017	安川電機	12.7	12.7	45,847
カゴメ	4.7	4.7	14,382	エーザイ	14.1	14.1	124,009	日本電気	12.4	12.4	74,524
日清食品HD	5	5	47,250	久光製薬	4.5	4.5	21,555	ファナック	9.7	9.7	181,390
日本たばこ産業	63.4	63.4	118,304	ツムラ	3.6	3.6	9,828	キャノン	63.4	63.4	113,961
繊維製品 (1.0%)				沢井製薬	2.1	2.1	10,962	輸送用機器 (0.7%)			
東レ	77.5	77.5	37,572	ゴム製品 (0.3%)				日野自動車	27.3	27.3	17,854
パルプ・紙 (0.3%)				横浜ゴム	8.1	8.1	11,834	NOK	8.2	8.2	9,995
レンゴー	12.9	12.9	10,565	ガラス・土石製品 (0.9%)				精密機器 (0.4%)			
化学 (18.5%)				AGC	10.8	10.8	33,642	助川電気工業	2.8	2.8	1,618
クラレ	16.9	16.9	18,150	鉄鋼 (2.3%)				ニコン	19.1	19.1	15,069
住友化学	78.6	78.6	25,230	日本製鉄	45.2	45.2	42,239	その他製品 (1.6%)			
								大日本印刷	15.4	15.4	36,544

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
	千株	千株	千円	
ビジョン	5.8	5.8	24,592	
日本アイ・エス・ケイ	0.8	0.8	800	
情報・通信業 (0.1%)				
アコムス	4.9	4.9	3,185	
卸売業 (-)				
日立ハイテク	6.5	-	-	
小売業 (11.5%)				
ホリフードサービス	1.1	2.7	1,260	
ジョイフル本田	49.1	49.1	75,073	
セブン&アイ・HL DGS	42.1	42.1	139,561	
JMホールディングス	12.7	12.7	45,148	
ライトオン	14.1	14.1	8,304	
しまむら	1.8	1.8	13,140	
ケーズホールディングス	111.8	111.8	157,526	
銀行業 (1.0%)				
めがきフィナンシャルG	56	56	13,832	
コンコルディア・フィナンシャル	59.1	59.1	19,739	
筑波銀行	39.2	39.2	6,507	

銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価額	評価額
	千株	千株	千円	
不動産業 (0.0%)				
香陵住販	0.5	0.5	688	
合計	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額
	1,673.4	1,658.6	3,826,457	3,826,457
	銘柄数<比率>	80銘柄	78銘柄	<91.8%>

(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各種業種の比率。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内 TOPIX	百万円 309	百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年7月29日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	3,826,457	91.4
コール・ローン等、その他	362,221	8.6
投資信託財産総額	4,188,679	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年7月29日現在

項目	当期末
(A) 資産	4,323,763,562円
コール・ローン等	335,561,932
株式(評価額)	3,826,457,730
未収配当金	15,234,900
差入委託証拠金	146,509,000
(B) 負債	155,890,200
未払金	15,808,200
未払解約金	4,998,000
差入委託証拠金代用有価証券	135,084,000
(C) 純資産総額(A - B)	4,167,873,362
元本	1,725,692,683
次期繰越損益金	2,442,180,679
(D) 受益権総口数	1,725,692,683口
1万口当り基準価額(C/D)	24,152円

* 期首における元本額は1,791,940,282円、当作成期間中における追加設定元本額は21,733,708円、同解約元本額は87,981,307円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、(FOFs専用) ダイワいばらきファンド (適格機関投資家専用) 164,394,721円、茨城ファンド1,561,297,962円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,152円です。

■損益の状況

当期 自2019年7月30日 至2020年7月29日

項目	当期
(A) 配当等収益	97,344,560円
受取配当金	97,479,950
受取利息	5,842
その他収益金	3,010
支払利息	△ 144,242
(B) 有価証券売買損益	8,869,401
売買益	416,977,850
売買損	△ 408,108,449
(C) 先物取引等損益	25,103,600
取引益	83,963,820
取引損	△ 58,860,220
(D) その他費用	△ 6,555
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	131,311,006
(F) 前期繰越損益金	2,413,920,074
(G) 解約差損益金	△ 133,812,693
(H) 追加信託差損益金	30,762,292
(I) 合計(E + F + G + H)	2,442,180,679
次期繰越損益金(I)	2,442,180,679

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。